

景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放 式指数证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20

§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	61
§9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末上市基金前十名持有人	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	63
§10 开放式基金份额变动	63
§11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	67
§12 影响投资者决策的其他重要信息	71
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF
场内简称	景顺 MSCI (扩位证券简称: 景顺 MSCIA 股 ETF)
基金主代码	512280
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 4 月 27 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	98,005,740.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金以 MSCI 中国 A 股国际通指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCIChina A Inclusion RMB Index (CNY))。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
		秦一楠
		010-66060069

电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	4008888606	95599
传真	0755-22381339	010-68121816
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	李进	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	40,399,877.26	59,340,509.47	138,671,790.17
本期利润	20,472,379.43	62,827,252.87	315,356,103.47
加权平均基金份额本期利润	0.2131	0.3993	0.4748
本期加权平均净值利润率	12.65%	32.49%	48.39%
本期基金份额净值增长率	12.04%	41.76%	37.29%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	75,652,302.25	65,861,396.99	37,702,172.31
期末可供分配基金份额利润	0.7719	0.5398	0.1156
期末基金资产净值	173,658,042.25	192,953,168.69	363,707,912.31
期末基金份额净值	1.7719	1.5815	1.1156
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	77.19%	58.15%	11.56%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

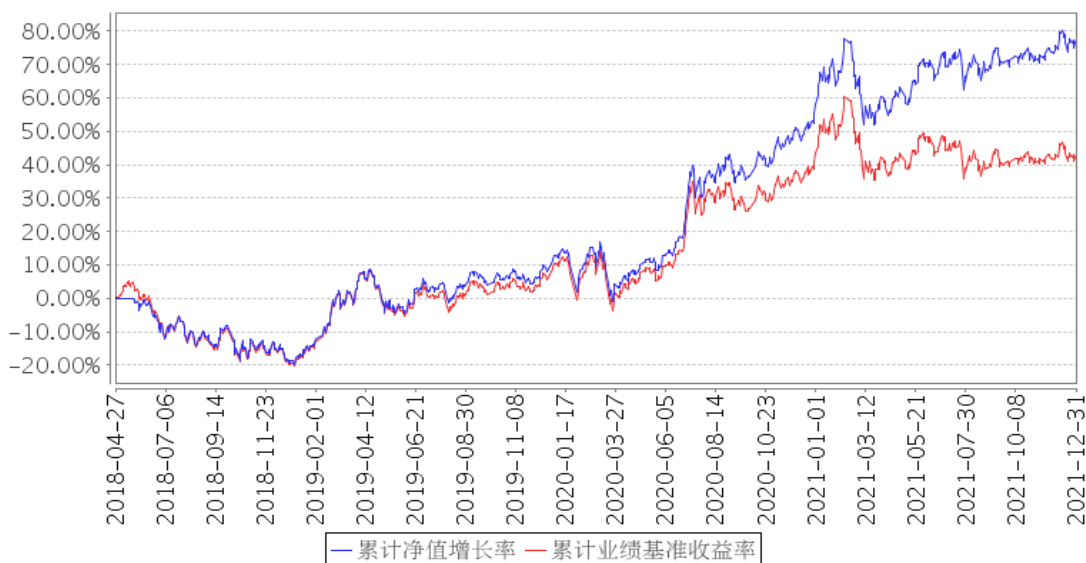
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.55%	0.75%	1.57%	0.75%	1.98%	0.00%
过去六个月	2.04%	0.97%	-3.66%	0.99%	5.70%	-0.02%
过去一年	12.04%	1.14%	-0.40%	1.16%	12.44%	-0.02%
过去三年	118.05%	1.25%	77.01%	1.28%	41.04%	-0.03%
自基金合同生效起至今	77.19%	1.27%	42.88%	1.30%	34.31%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

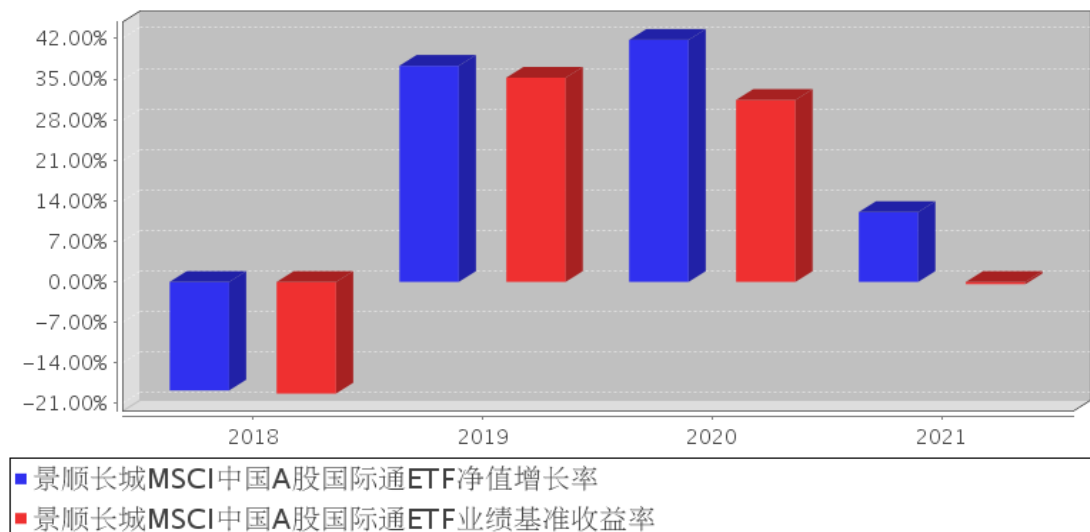
景顺长城MSCI中国A股国际通ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。本基金的建仓期为自2018年4月27日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城MSCI中国A股国际通ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2018 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间为 2018 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2021年12月31日，本公司旗下共管理140只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产

配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张 晓 南	本基金的 基金经理	2020 年 7 月 3 日	-	11 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 投资部基金经理。具有 11 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公

司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 25 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年 12 月工业增加值当月同比增长 4.30%，前值 3.80%，整体表现较为低迷；当月环比增长 0.42%，相比之前略有好转，仍然处于后疫情时代复苏区间。12 月 PMI 指数为 50.30，维持在 50 以上，相较前两个月有所回暖。12 月 PPI 同比增长 10.30%，前值 12.90%，环比增长-1.20%；CPI 同比增长 1.50%，前值 2.30%，环比增长-0.30%，经济增长预期略有下降。12 月 M2 同比增长 9.00%，M1 同比增长 3.50%，社会融资规模存量同比增长 10.30%，增速逐渐降低至均衡水平。12 月末外汇储备 3.25 万亿美元，再创近期新高。2021 年全年行情震荡，风格转换较为频繁，截至 2021 年底，上证综指、深证成指、沪深 300、中证 500、创业板指和科创 50 的收益率分别为 4.80%、2.67%、-5.20%、15.58%、12.02%和 0.37%。就全年行情来看，在去年四季度市场回暖后，一季度多数板块有所回调，二季度以芯片及新能源车为代表的科技板块显示出明显的盈利驱动复苏态势，三季度更多的是中小企业盈利增速复苏叠加专精特新“小巨人”等政策刺激有所表现，其他板块出现获利回吐，四季度市场回暖，但中小企业仍保持强势，中小市值企业占比较高的中证 500 和深证成指表现优异。

由于新的新冠病毒变种 Omicron 的出现，美国每日新增确诊接近 100 万人，拜登政府上台后累计死亡人数已经超过 40 万人；法国每日新增确诊超过 40 万人；日本也再次出现爆发，单日新增确诊最高超过 5 万人。Omicron 较高的传染性、较长的潜伏期令疫情防控难度再次增加，虽然

症状较 Delta 为轻，免疫能力较弱的老人与小孩仍面临巨大的威胁。同时新的变种令现有疫苗的保护率有所下降，对当前疫苗接种率较高的国家的防疫工作提出了挑战。

国内当前也出现了零星的疫情复发，在“动态清零”的防疫政策下，当前已经基本得到了控制。国内经济目前仍然能够受益于全球其它国家经济活动的低迷，在全球主要经济体经济增长停滞甚至衰退的形势下，国内生产厂商在国内疫情结束较早、生产恢复较快的情形下，相当大一部分的填补了国内外需求缺口，且在国外尚未完全走出疫情影响前，这一趋势并不会发生转变。而在全球经济摆脱疫情影响后，国内生产厂商在全球供应链中的地位也会有所提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年，本基金份额净值增长率为 12.04%，业绩比较基准收益率为-0.40%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，跟踪误差（年化）控制在 2%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，疫情短时间内无法得到有效控制，目前变异毒株的快速传播可能令后续疫情形势发生变化。在全球疫苗接种率逐渐提高，同时各国医疗资源充沛后可能将疫情压制到较低水平，并开始真正的全球经济复苏。全球产能恢复的速度在当前时点无法明确预见，而“中国制造”为全球工业品和消费品的生产做出了卓越的贡献，也为国内经济增长提供了坚实的基础。2021 年 12 月的中央经济工作会议提出要“全面实行股票发行注册制”，预计后续相关政策将陆续出台。在整体经济复苏加快的基础上，资本市场仍有强大的吸引力，我们对市场保持乐观。当前继续看好成长板块在全球经济复苏阶段的表现，后续成长性高、现金流好、行业竞争格局稳定且公司地位明确的股票更有优势。

本基金采用完全复制 MSCI 中国 A 股国际通指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况，根据指数成份股及其权重变化定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金

份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI(Key Performance Indicator 主要绩效指标)为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告**6.1 审计报告基本信息**

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 24416 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“景顺长城 MSCI ETF”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了景顺长城 MSCI ETF 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城 MSCI ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>景顺长城 MSCI ETF 的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城 MSCI ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城 MSCI ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城 MSCI ETF 的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对景顺长城 MSCI ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致景顺长城 MSCI ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	郭劲扬
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2022 年 3 月 24 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,999,846.12	3,919,553.36
结算备付金		158,463.18	200,323.57
存出保证金		31,134.97	89,999.34
交易性金融资产	7.4.7.2	169,756,197.23	189,005,490.65
其中：股票投资		169,564,197.23	188,974,425.55
基金投资		-	-
债券投资		192,000.00	31,065.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		99,802.94	375,641.14
应收利息	7.4.7.5	866.29	1,127.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	1.80
资产总计		174,046,310.73	193,592,137.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		72,191.88	76,553.89
应付托管费		14,438.34	15,310.77

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	61,757.29	104,486.80
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	239,880.97	442,617.46
负债合计		388,268.48	638,968.92
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	98,005,740.00	122,005,740.00
未分配利润	7.4.7.10	75,652,302.25	70,947,428.69
所有者权益合计		173,658,042.25	192,953,168.69
负债和所有者权益总计		174,046,310.73	193,592,137.61

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7719 元，基金份额总额 98,005,740.00 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		22,271,861.27	65,128,910.24
1. 利息收入		28,501.15	50,545.19
其中：存款利息收入	7.4.7.11	28,448.58	50,497.69
债券利息收入		52.57	47.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		40,766,188.24	60,632,179.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	38,406,623.09	57,887,742.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	94,187.49	85,820.34
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,265,377.66	2,658,616.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-19,927,497.83	3,486,743.40
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.17	1,404,669.71	959,442.54
减: 二、费用		1,799,481.84	2,301,657.37
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	811,156.10	976,242.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	162,231.15	195,248.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	512,245.38	810,709.28
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.02	0.06
7. 其他费用	7.4.7.19	313,849.19	319,457.27
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		20,472,379.43	62,827,252.87
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		20,472,379.43	62,827,252.87

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	122,005,740.00	70,947,428.69	192,953,168.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	20,472,379.43	20,472,379.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-24,000,000.00	-15,767,505.87	-39,767,505.87
其中: 1. 基金申购款	82,000,000.00	55,447,878.89	137,447,878.89
2. 基金赎回款	-106,000,000.00	-71,215,384.76	-177,215,384.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	98,005,740.00	75,652,302.25	173,658,042.25

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	326,005,740.00	37,702,172.31	363,707,912.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	62,827,252.87	62,827,252.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-204,000,000.00	-29,581,996.49	-233,581,996.49
其中：1. 基金申购款	190,000,000.00	54,693,050.71	244,693,050.71
2. 基金赎回款	-394,000,000.00	-84,275,047.20	-478,275,047.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	122,005,740.00	70,947,428.69	192,953,168.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]548 号《关于准予景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,533,998,240.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0283 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,534,005,740.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 7,500.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金

管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证函[2018]67号文审核同意，本基金 1,534,005,740.00 份基金份额于 2018 年 5 月 25 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数 MSCI 中国 A 股国际通指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、股指期货、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index (CNY))。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”)。景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2022 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。本基金收益每年最多分配 12 次，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	3,999,846.12	3,919,553.36
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-	-
存款期限 1 年（含）以上	-	-
其他存款	-	-
合计	3,999,846.12	3,919,553.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	161,544,541.38	169,564,197.23	8,019,655.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	192,000.00	-
	银行间市场	-	-

	合计	192,000.00	192,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		161,736,541.38	169,756,197.23	8,019,655.85
项目	上年度末			
	2020年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		161,030,336.97	188,974,425.55	27,944,088.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	28,000.00	31,065.10	3,065.10
	银行间市场	-	-	-
	合计	28,000.00	31,065.10	3,065.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		161,058,336.97	189,005,490.65	27,947,153.68

注：于2021年12月31日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值-564.00元(2020年12月31日：564.00元)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末的衍生金融资产/负债余额为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	776.28	995.32
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	71.30	90.10
应收债券利息	4.61	1.83
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-

应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	14.10	40.50
合计	866.29	1,127.75

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
可退替代款	-	1.80
合计	-	1.80

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	61,757.29	104,486.80
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	61,757.29	104,486.80

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	175,000.00	295,000.00
应付指数使用费	64,880.97	33,165.87
应退替代款	-	114,451.59
合计	239,880.97	442,617.46

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,005,740.00	122,005,740.00
本期申购	82,000,000.00	82,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-106,000,000.00	-106,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	98,005,740.00	98,005,740.00
-----	---------------	---------------

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	65,861,396.99	5,086,031.70	70,947,428.69
本期利润	40,399,877.26	-19,927,497.83	20,472,379.43
本期基金份额交易产生的变动数	-13,020,763.65	-2,746,742.22	-15,767,505.87
其中：基金申购款	65,670,239.24	-10,222,360.35	55,447,878.89
基金赎回款	-78,691,002.89	7,475,618.13	-71,215,384.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,240,510.60	-17,588,208.35	75,652,302.25

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	25,185.46	44,348.80
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,580.86	4,705.40
其他	682.26	1,443.49
合计	28,448.58	50,497.69

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	29,158,064.99	44,701,417.46
股票投资收益——赎回差价收入	9,248,558.10	13,186,324.59
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	38,406,623.09	57,887,742.05

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	164,707,604.90	284,306,960.43
减：卖出股票成本总额	135,549,539.91	239,605,542.97

买卖股票差价收入	29,158,064.99	44,701,417.46
----------	---------------	---------------

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	177,215,384.76	478,275,047.20
减：现金支付赎回款总额	73,097,275.76	190,526,396.20
减：赎回股票成本总额	94,869,550.90	274,562,326.41
赎回差价收入	9,248,558.10	13,186,324.59

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	560,437.48	362,166.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	466,200.00	276,300.00
减：应收利息总额	49.99	46.21
买卖债券差价收入	94,187.49	85,820.34

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,265,377.66	2,658,616.72
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,265,377.66	2,658,616.72

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-19,927,497.83	3,486,743.40
股票投资	-19,924,432.73	3,483,678.30
债券投资	-3,065.10	3,065.10
资产支持证券投资	-	-

基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-19,927,497.83	3,486,743.40

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益-564.00元(上年度可比期间：564.00元)。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	348,271.54	959,442.54
其他	1,056,398.17	-
合计	1,404,669.71	959,442.54

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	512,245.38	810,709.28
银行间市场交易费用	-	-
合计	512,245.38	810,709.28

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	55,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	8,086.14	10,084.31
指数使用费	130,403.05	134,012.96
其他	360.00	360.00

合计	313,849.19	319,457.27
----	------------	------------

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.0125% 的季费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）美元 5,000 元。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司
景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
长城证券	-	-	4,573,086.39	0.92

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	4,258.99	0.92	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	811,156.10
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	162,231.15

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)
景顺长城MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金	22,352,800.00	22.81	27,922,500.00	22.89

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期	3,999,846.12	25,185.46	3,919,553.36	44,348.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2021年12月31日，本基金持有9,700股长城证券的A股普通股，成本总额为人民币110,364.48元，估值总额为人民币125,615.00元，占基金资产净值的比例为0.07%；本基金持有281,700股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币883,962.73元，估值总额为人民币828,198.00元，占基金资产净值的比例为0.48%（2020年12月31日：本基金持有9,500股长城

证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 124,449.06 元，估值总额为人民币 122,265.00 元，占基金资产净值的比例为 0.06%；本基金持有 338,900 股中国农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,121,929.02 元，估值总额为人民币 1,064,146.00 元，占基金资产净值的比例为 0.55%。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	694	3,685.14	9,369.00	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股流通受限	14.14	89.87	391	5,528.74	35,139.17	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	208	4,584.32	11,706.24	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股流通受限	23.38	29.93	169	3,951.22	5,058.17	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股流通受限	6.96	12.51	744	5,178.24	9,307.44	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年2月17日	新股流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	193	3,732.62	6,353.56	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-

301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股流通受限	12.95	17.44	383	4,959.85	6,679.52	-
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	新股流通受限	15.48	21.53	831	12,863.88	17,891.43	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股流通受限	93.09	75.34	105	9,774.45	7,910.70	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股流通受限	33.16	24.67	192	6,366.72	4,736.64	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	36.31	35.52	133	4,829.23	4,724.16	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	58.08	49.85	115	6,679.20	5,732.75	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股流通受限	79.60	78.53	55	4,378.00	4,319.15	-
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	新股流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新股流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股流通受限	27.81	31.14	191	5,311.71	5,947.74	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股流通受限	26.91	43.36	208	5,597.28	9,018.88	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股流通受限	57.27	53.71	70	4,008.90	3,759.70	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股流通受限	22.70	49.02	234	5,311.80	11,470.68	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	12.37	19.23	467	5,776.79	8,980.41	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股流通受限	12.03	17.12	640	7,699.20	10,956.80	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	26.17	44.86	181	4,736.77	8,119.66	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股流通受限	10.07	16.76	689	6,938.23	11,547.64	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股流通受限	60.66	96.75	135	8,189.10	13,061.25	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股流通受限	39.08	52.13	135	5,275.80	7,037.55	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	116.88	116.08	80	9,350.40	9,286.40	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股流通受限	43.99	50.77	90	3,959.10	4,569.30	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	212	5,749.44	6,482.96	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股流通受限	13.00	20.48	458	5,954.00	9,379.84	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	66.18	56.62	102	6,750.36	5,775.24	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	183	5,096.55	5,025.18	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股流通受限	30.73	29.14	165	5,070.45	4,808.10	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	219	4,765.44	6,394.80	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	29.28	32.00	176	5,153.28	5,632.00	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	281	7,249.80	9,455.65	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	80	5,591.20	7,097.60	-
688038	中科通达	2021年7月5日	2022年1月13日	新股流通受限	8.60	18.72	2,132	18,335.20	39,911.04	-
688071	华依科技	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-
688082	盛美上海	2021年11月10日	2022年5月18日	新股流通受限	85.00	114.28	1,067	90,695.00	121,936.76	-

688236	春立医疗	2021年12月23日	2022年6月30日	新股流通受限	29.81	26.43	1,812	54,015.72	47,891.16	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股流通受限	41.98	41.98	1,562	65,572.76	65,572.76	-
688296	和达科技	2021年7月19日	2022年1月27日	新股流通受限	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688701	卓锦股份	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月28日	2022年1月14日	新债流通受限	100.00	100.00	1,890	189,000.00	189,000.00	-
113634	珀莱转债	2021年12月9日	2022年1月4日	新债流通受限	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-

注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终可流通日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.11%（上年度末：0.02%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行

的可流通股，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	3,999,846.12	-	-	-	-	-	3,999,846.12
结算备付金	158,463.18	-	-	-	-	-	158,463.18
存出保证金	31,134.97	-	-	-	-	-	31,134.97
交易性金融资产	-	-	-	-	192,000.00	169,564,197.23	169,756,197.23
应收利息	-	-	-	-	-	866.29	866.29
应收证券清算款	-	-	-	-	-	99,802.94	99,802.94
资产总计	4,189,444.27	-	-	-	192,000.00	169,664,866.46	174,046,310.73
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	72,191.88	72,191.88
应付托管费	-	-	-	-	-	14,438.34	14,438.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	61,757.29	61,757.29
其他负债	-	-	-	-	-	239,880.97	239,880.97
负债总计	-	-	-	-	-	388,268.48	388,268.48
利率敏感度缺口	4,189,444.27	-	-	-	192,000.00	-	-
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,919,553.36	-	-	-	-	-	3,919,553.36
结算备付金	200,323.57	-	-	-	-	-	200,323.57
存出保证金	89,999.34	-	-	-	-	-	89,999.34
交易性金融资产	-	-	-	-	31,065.10	188,974,425.55	189,005,490.65
应收利息	-	-	-	-	-	1,127.75	1,127.75
应收证券清算款	-	-	-	-	-	375,641.14	375,641.14
其他资产	-	-	-	-	-	1.80	1.80
资产总计	4,209,876.27	-	-	-	31,065.10	189,351,196.24	193,592,137.61
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	76,553.89	76,553.89
应付托管费	-	-	-	-	-	15,310.77	15,310.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	104,486.80	104,486.80
其他负债	-	-	-	-	-	442,617.46	442,617.46
负债总计	-	-	-	-	-	638,968.92	638,968.92
利率敏感度缺口	4,209,876.27	-	-	-	31,065.10	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.11%（上年度末：0.02%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	169,564,197.23	97.64	188,974,425.55	97.94
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	169,564,197.23	97.64	188,974,425.55	97.94

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	8,143,452.23	9,756,420.70
	沪深 300 指数下降 5%	-8,143,452.23	-9,756,420.70

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 168,477,302.91 元，属于第二层次的余额为 1,278,894.32 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 186,970,719.50 元，第二层次 2,034,771.15，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 基金申购款

于 2021 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 137,447,878.89 元(2020 年度：244,693,050.71 元)，其中包括以股票支付的申购款 70,100,220.34 元和以现金支付的申购款 67,347,658.55 元(2020 年度：其中包括以股票支付的申购款 121,783,136.39 元和以现金支付的申购款 122,909,914.32 元)。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募

证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(4)除公允价值、基金申购款和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	169,564,197.23	97.42
	其中：股票	169,564,197.23	97.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	192,000.00	0.11
	其中：债券	192,000.00	0.11
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,158,309.30	2.39
8	其他各项资产	131,804.20	0.08
9	合计	174,046,310.73	100.00

注：本表权益投资股票项中，含可退替代款估值增值 0.00 元，而 8.2 中不含可退替代款估值增值，因此二者存在差异。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,966,127.32	1.13
B	采矿业	4,559,971.57	2.63
C	制造业	102,079,223.67	58.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,183,883.43	2.41
E	建筑业	2,719,133.40	1.57
F	批发和零售业	1,568,877.60	0.90

G	交通运输、仓储和邮政业	4,671,147.27	2.69
H	住宿和餐饮业	199,240.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,359,806.55	3.66
J	金融业	30,339,831.60	17.47
K	房地产业	2,855,332.74	1.64
L	租赁和商务服务业	2,279,166.40	1.31
M	科学研究和技术服务业	2,045,163.80	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	414,730.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,409,042.56	0.81
R	文化、体育和娱乐业	681,940.20	0.39
S	综合	139,971.00	0.08
	合计	168,472,589.11	97.01

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	645,789.09	0.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.01
F	批发和零售业	48,050.81	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	237,314.09	0.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	53,949.97	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	63,799.75	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,091,608.12	0.63

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,787	9,813,350.00	5.65
2	300750	宁德时代	8,815	5,183,220.00	2.98
3	600036	招商银行	78,078	3,803,179.38	2.19
4	000858	五粮液	14,772	3,289,133.52	1.89
5	601318	中国平安	41,037	2,068,675.17	1.19
6	600900	长江电力	86,012	1,952,472.40	1.12
7	002594	比亚迪	6,920	1,855,390.40	1.07
8	601012	隆基股份	20,528	1,769,513.60	1.02
9	300760	迈瑞医疗	4,600	1,751,680.00	1.01
10	601888	中国中免	7,400	1,623,634.00	0.93
11	601166	兴业银行	78,600	1,496,544.00	0.86
12	600809	山西汾酒	4,641	1,465,534.98	0.84
13	300059	东方财富	39,084	1,450,407.24	0.84
14	000568	泸州老窖	5,535	1,405,170.45	0.81
15	603288	海天味业	13,285	1,396,386.35	0.80
16	002475	立讯精密	26,680	1,312,656.00	0.76
17	002352	顺丰控股	18,550	1,278,466.00	0.74
18	600276	恒瑞医药	24,234	1,228,906.14	0.71
19	000001	平安银行	73,400	1,209,632.00	0.70
20	600309	万华化学	11,865	1,198,365.00	0.69
21	603259	药明康德	9,740	1,154,969.20	0.67
22	601398	工商银行	238,000	1,101,940.00	0.63
23	600030	中信证券	40,300	1,064,323.00	0.61
24	002714	牧原股份	19,922	1,063,037.92	0.61
25	603501	韦尔股份	3,300	1,025,541.00	0.59
26	600436	片仔癀	2,304	1,007,193.60	0.58
27	600887	伊利股份	24,200	1,003,332.00	0.58
28	002142	宁波银行	24,966	955,698.48	0.55
29	600000	浦发银行	111,000	946,830.00	0.55
30	002304	洋河股份	5,713	941,102.49	0.54
31	601919	中远海控	47,843	894,185.67	0.51
32	300015	爱尔眼科	20,457	864,921.96	0.50
33	002812	恩捷股份	3,400	851,360.00	0.49
34	300014	亿纬锂能	7,185	849,123.30	0.49
35	600406	国电南瑞	20,953	838,748.59	0.48
36	601288	农业银行	281,700	828,198.00	0.48

37	300274	阳光电源	5,500	801,900.00	0.46
38	601668	中国建筑	158,660	793,300.00	0.46
39	600438	通威股份	17,068	767,377.28	0.44
40	300122	智飞生物	6,100	760,060.00	0.44
41	601899	紫金矿业	77,800	754,660.00	0.43
42	601816	京沪高铁	154,700	747,201.00	0.43
43	600031	三一重工	32,100	731,880.00	0.42
44	000002	万科 A	36,685	724,895.60	0.42
45	000725	京东方 A	141,800	716,090.00	0.41
46	600690	海尔智家	23,834	712,398.26	0.41
47	600048	保利发展	45,200	706,476.00	0.41
48	601601	中国太保	25,800	699,696.00	0.40
49	002241	歌尔股份	12,900	697,890.00	0.40
50	002493	荣盛石化	38,250	694,620.00	0.40
51	002371	北方华创	2,000	694,040.00	0.40
52	601328	交通银行	148,400	684,124.00	0.39
53	300124	汇川技术	9,937	681,678.20	0.39
54	600893	航发动力	10,082	639,803.72	0.37
55	600111	北方稀土	13,703	627,597.40	0.36
56	002460	赣锋锂业	4,350	621,397.50	0.36
57	600585	海螺水泥	15,149	610,504.70	0.35
58	600745	闻泰科技	4,700	607,710.00	0.35
59	600104	上汽集团	29,395	606,418.85	0.35
60	600019	宝钢股份	84,156	602,556.96	0.35
61	002459	晶澳科技	6,100	565,470.00	0.33
62	601088	中国神华	24,930	561,423.60	0.32
63	601766	中国中车	92,000	560,280.00	0.32
64	000776	广发证券	22,300	548,357.00	0.32
65	600016	民生银行	134,060	522,834.00	0.30
66	601818	光大银行	156,400	519,248.00	0.30
67	002049	紫光国微	2,300	517,500.00	0.30
68	601658	邮储银行	100,500	512,550.00	0.30
69	002129	中环股份	12,200	509,350.00	0.29
70	600028	中国石化	120,400	509,292.00	0.29
71	601211	国泰君安	28,428	508,576.92	0.29
72	600346	恒力石化	22,140	508,555.80	0.29
73	603799	华友钴业	4,610	508,529.10	0.29
74	000538	云南白药	4,800	502,320.00	0.29
75	600999	招商证券	28,020	494,553.00	0.28
76	601688	华泰证券	27,809	493,887.84	0.28
77	000063	中兴通讯	14,600	489,100.00	0.28
78	300896	爱美客	900	482,499.00	0.28

79	600010	包钢股份	172,400	480,996.00	0.28
80	601066	中信建投	16,300	476,775.00	0.27
81	603806	福斯特	3,620	472,591.00	0.27
82	601669	中国电建	57,800	467,024.00	0.27
83	300498	温氏股份	24,040	463,010.40	0.27
84	002311	海大集团	6,300	461,790.00	0.27
85	600050	中国联通	117,200	460,596.00	0.27
86	000338	潍柴动力	25,600	457,984.00	0.26
87	002230	科大讯飞	8,700	456,837.00	0.26
88	601985	中国核电	55,000	456,500.00	0.26
89	002027	分众传媒	55,460	454,217.40	0.26
90	603986	兆易创新	2,580	453,693.00	0.26
91	600837	海通证券	36,424	446,558.24	0.26
92	601225	陕西煤业	36,600	446,520.00	0.26
93	601390	中国中铁	77,000	445,830.00	0.26
94	600588	用友网络	12,322	442,113.36	0.25
95	601877	正泰电器	8,100	436,509.00	0.25
96	000166	申万宏源	85,200	436,224.00	0.25
97	002821	凯莱英	1,000	435,000.00	0.25
98	000661	长春高新	1,600	434,240.00	0.25
99	300433	蓝思科技	18,800	432,024.00	0.25
100	300782	卓胜微	1,300	424,840.00	0.24
101	603659	璞泰来	2,640	424,010.40	0.24
102	002709	天赐材料	3,660	419,619.00	0.24
103	600150	中国船舶	16,900	418,951.00	0.24
104	688036	传音控股	2,622	411,391.80	0.24
105	601633	长城汽车	8,400	407,736.00	0.23
106	601100	恒立液压	4,964	406,055.20	0.23
107	601988	中国银行	132,800	405,040.00	0.23
108	600989	宝丰能源	23,100	401,016.00	0.23
109	601857	中国石油	81,649	400,896.59	0.23
110	300413	芒果超媒	6,990	399,967.80	0.23
111	001979	招商蛇口	29,900	398,866.00	0.23
112	688111	金山办公	1,485	393,525.00	0.23
113	000596	古井贡酒	1,600	390,400.00	0.22
114	601229	上海银行	53,704	382,909.52	0.22
115	603993	洛阳钼业	66,800	372,744.00	0.21
116	600196	复星医药	7,608	372,335.52	0.21
117	000625	长安汽车	23,935	363,572.65	0.21
118	601169	北京银行	79,900	354,756.00	0.20
119	603392	万泰生物	1,600	354,400.00	0.20
120	600660	福耀玻璃	7,500	353,550.00	0.20

121	300759	康龙化成	2,500	353,175.00	0.20
122	600570	恒生电子	5,541	344,373.15	0.20
123	000895	双汇发展	10,900	343,895.00	0.20
124	601360	三六零	27,011	343,579.92	0.20
125	002050	三花智控	13,570	343,321.00	0.20
126	300999	金龙鱼	5,400	339,822.00	0.20
127	601009	南京银行	37,766	338,383.36	0.19
128	600741	华域汽车	11,900	336,770.00	0.19
129	300316	晶盛机电	4,800	333,600.00	0.19
130	300142	沃森生物	5,903	331,748.60	0.19
131	600958	东方证券	22,500	331,650.00	0.19
132	601138	工业富联	27,457	327,287.44	0.19
133	000100	TCL 科技	53,000	327,010.00	0.19
134	688169	石头科技	400	325,200.00	0.19
135	600919	江苏银行	55,780	325,197.40	0.19
136	600886	国投电力	28,100	322,307.00	0.19
137	300408	三环集团	7,200	321,120.00	0.18
138	002074	国轩高科	6,200	317,750.00	0.18
139	601628	中国人寿	10,450	314,440.50	0.18
140	688012	中微公司	2,445	309,537.00	0.18
141	601865	福莱特	5,300	307,082.00	0.18
142	300454	深信服	1,600	305,600.00	0.18
143	601336	新华保险	7,819	304,002.72	0.18
144	002001	新和成	9,740	303,108.80	0.17
145	601600	中国铝业	49,400	300,846.00	0.17
146	600089	特变电工	14,044	297,311.48	0.17
147	300033	同花顺	2,000	289,160.00	0.17
148	600926	杭州银行	22,400	287,168.00	0.17
149	603833	欧派家居	1,887	278,332.50	0.16
150	300661	圣邦股份	900	278,100.00	0.16
151	002736	国信证券	24,200	277,816.00	0.16
152	601117	中国化学	23,100	277,200.00	0.16
153	300628	亿联网络	3,403	277,174.35	0.16
154	600176	中国巨石	15,073	274,328.60	0.16
155	300207	欣旺达	6,500	274,040.00	0.16
156	600132	重庆啤酒	1,800	272,376.00	0.16
157	600029	南方航空	39,900	271,719.00	0.16
158	603486	科沃斯	1,800	271,710.00	0.16
159	600015	华夏银行	48,418	271,140.80	0.16
160	600011	华能国际	27,687	268,287.03	0.15
161	603290	斯达半导	700	266,700.00	0.15
162	000963	华东医药	6,617	266,003.40	0.15

163	600460	士兰微	4,900	265,580.00	0.15
164	600600	青岛啤酒	2,682	265,518.00	0.15
165	002013	中航机电	14,600	265,428.00	0.15
166	002236	大华股份	11,300	265,324.00	0.15
167	000723	美锦能源	16,100	261,303.00	0.15
168	002648	卫星化学	6,460	258,593.80	0.15
169	000876	新希望	17,001	258,585.21	0.15
170	601618	中国中冶	67,500	258,525.00	0.15
171	300751	迈为股份	400	256,920.00	0.15
172	300601	康泰生物	2,600	256,204.00	0.15
173	600547	山东黄金	13,604	256,027.28	0.15
174	603369	今世缘	4,700	255,680.00	0.15
175	000799	酒鬼酒	1,200	255,000.00	0.15
176	002601	龙佰集团	8,900	254,451.00	0.15
177	002180	纳思达	5,300	253,128.00	0.15
178	600845	宝信软件	4,140	251,836.20	0.15
179	601377	兴业证券	25,300	249,964.00	0.14
180	600426	华鲁恒升	7,940	248,522.00	0.14
181	601155	新城控股	8,500	247,605.00	0.14
182	000938	紫光股份	10,779	246,300.15	0.14
183	002938	鹏鼎控股	5,800	246,094.00	0.14
184	601901	方正证券	31,128	244,043.52	0.14
185	300223	北京君正	1,800	241,200.00	0.14
186	002920	德赛西威	1,700	240,567.00	0.14
187	600763	通策医疗	1,200	238,800.00	0.14
188	000733	振华科技	1,900	236,132.00	0.14
189	002602	世纪华通	28,120	235,926.80	0.14
190	601727	上海电气	48,300	234,738.00	0.14
191	000301	东方盛虹	12,100	234,014.00	0.13
192	688008	澜起科技	2,764	231,816.68	0.13
193	601111	中国国航	25,100	229,163.00	0.13
194	603899	晨光文具	3,500	225,785.00	0.13
195	000786	北新建材	6,300	225,729.00	0.13
196	600875	东方电气	10,500	224,910.00	0.13
197	601799	星宇股份	1,100	224,675.00	0.13
198	002555	三七互娱	8,300	224,266.00	0.13
199	002120	韵达股份	10,910	223,218.60	0.13
200	002756	永兴材料	1,500	222,030.00	0.13
201	300496	中科创达	1,600	221,472.00	0.13
202	600383	金地集团	17,062	221,294.14	0.13
203	601916	浙商银行	63,176	221,116.00	0.13
204	601788	光大证券	14,727	219,874.11	0.13

205	600188	兖矿能源	9,300	218,829.00	0.13
206	300450	先导智能	2,940	218,647.80	0.13
207	600918	中泰证券	21,900	218,343.00	0.13
208	000069	华侨城 A	31,000	218,240.00	0.13
209	002791	坚朗五金	1,200	217,908.00	0.13
210	601689	拓普集团	4,100	217,300.00	0.13
211	002916	深南电路	1,780	216,839.60	0.12
212	600039	四川路桥	18,000	216,720.00	0.12
213	600779	水井坊	1,800	215,982.00	0.12
214	600233	圆通速递	12,900	215,172.00	0.12
215	002414	高德红外	8,860	214,500.60	0.12
216	002080	中材科技	6,300	214,326.00	0.12
217	002202	金风科技	12,984	213,846.48	0.12
218	600795	国电电力	67,400	213,658.00	0.12
219	600219	南山铝业	45,200	212,892.00	0.12
220	601939	建设银行	36,200	212,132.00	0.12
221	603260	合盛硅业	1,600	211,152.00	0.12
222	600563	法拉电子	900	209,160.00	0.12
223	600885	宏发股份	2,800	208,992.00	0.12
224	300763	锦浪科技	900	208,395.00	0.12
225	600584	长电科技	6,700	207,834.00	0.12
226	600183	生益科技	8,700	204,885.00	0.12
227	002007	华兰生物	6,890	200,774.60	0.12
228	600754	锦江酒店	3,400	199,240.00	0.11
229	600061	国投资本	24,231	199,178.82	0.11
230	002841	视源股份	2,434	198,127.60	0.11
231	688126	沪硅产业	7,621	196,774.22	0.11
232	002600	领益智造	26,700	196,512.00	0.11
233	601995	中金公司	4,000	196,120.00	0.11
234	000977	浪潮信息	5,456	195,488.48	0.11
235	600522	中天科技	11,500	195,040.00	0.11
236	002625	光启技术	8,100	194,481.00	0.11
237	600018	上港集团	35,200	192,896.00	0.11
238	601233	桐昆股份	9,100	192,738.00	0.11
239	603707	健友股份	4,584	192,528.00	0.11
240	601878	浙商证券	14,600	192,428.00	0.11
241	000157	中联重科	26,800	192,156.00	0.11
242	601615	明阳智能	7,300	190,530.00	0.11
243	603882	金城医学	1,700	189,329.00	0.11
244	603737	三棵树	1,360	189,244.00	0.11
245	601966	玲珑轮胎	5,160	188,598.00	0.11
246	600298	安琪酵母	3,100	187,116.00	0.11

247	002340	格林美	18,000	186,300.00	0.11
248	002240	盛新锂能	3,200	185,440.00	0.11
249	603160	汇顶科技	1,700	183,209.00	0.11
250	002064	华峰化学	17,500	182,700.00	0.11
251	300595	欧普康视	3,180	182,436.60	0.11
252	601881	中国银河	16,200	181,278.00	0.10
253	002268	卫士通	3,200	179,008.00	0.10
254	300347	泰格医药	1,400	178,920.00	0.10
255	600332	白云山	5,226	178,729.20	0.10
256	300390	天华超净	2,200	178,200.00	0.10
257	600115	中国东航	34,500	178,020.00	0.10
258	603816	顾家家居	2,300	177,468.00	0.10
259	000425	徐工机械	29,600	177,304.00	0.10
260	600038	中直股份	2,200	176,660.00	0.10
261	603456	九洲药业	3,100	174,406.00	0.10
262	600362	江西铜业	7,800	174,174.00	0.10
263	603198	迎驾贡酒	2,500	173,625.00	0.10
264	002384	东山精密	6,400	173,440.00	0.10
265	002252	上海莱士	25,400	173,228.00	0.10
266	688180	君实生物	2,586	173,210.28	0.10
267	601636	旗滨集团	10,100	172,710.00	0.10
268	300146	汤臣倍健	6,400	172,544.00	0.10
269	600674	川投能源	13,800	172,500.00	0.10
270	603568	伟明环保	4,700	171,691.00	0.10
271	601058	赛轮轮胎	11,500	170,085.00	0.10
272	300037	新宙邦	1,500	169,500.00	0.10
273	002326	永太科技	3,300	168,993.00	0.10
274	601555	东吴证券	19,059	168,862.74	0.10
275	600009	上海机场	3,600	168,084.00	0.10
276	603185	上机数控	1,000	166,980.00	0.10
277	601216	君正集团	31,900	166,837.00	0.10
278	600256	广汇能源	25,500	166,770.00	0.10
279	603605	珀莱雅	800	166,648.00	0.10
280	002568	百润股份	2,780	166,327.40	0.10
281	300073	当升科技	1,900	165,053.00	0.10
282	002385	大北农	15,600	163,644.00	0.09
283	600803	新奥股份	8,900	163,404.00	0.09
284	601838	成都银行	13,600	163,200.00	0.09
285	300529	健帆生物	3,030	161,499.00	0.09
286	603267	鸿远电子	900	161,496.00	0.09
287	300699	光威复材	1,900	160,512.00	0.09
288	600141	兴发集团	4,200	159,096.00	0.09

289	688006	杭可科技	1,471	158,250.18	0.09
290	000783	长江证券	20,900	157,586.00	0.09
291	000066	中国长城	11,100	157,176.00	0.09
292	603517	绝味食品	2,300	157,159.00	0.09
293	688122	西部超导	1,618	156,848.92	0.09
294	603589	口子窖	2,200	155,914.00	0.09
295	600352	浙江龙盛	12,300	155,349.00	0.09
296	600516	方大炭素	14,314	154,877.48	0.09
297	000739	普洛药业	4,400	154,396.00	0.09
298	688188	柏楚电子	400	154,184.00	0.09
299	300003	乐普医疗	6,800	153,884.00	0.09
300	002185	华天科技	12,100	153,791.00	0.09
301	603345	安井食品	900	153,702.00	0.09
302	603019	中科曙光	5,500	151,635.00	0.09
303	000825	太钢不锈	21,500	151,360.00	0.09
304	601108	财通证券	13,500	150,120.00	0.09
305	300726	宏达电子	1,500	150,090.00	0.09
306	300724	捷佳伟创	1,300	148,590.00	0.09
307	000738	航发控制	4,900	148,372.00	0.09
308	600161	天坛生物	5,120	148,275.20	0.09
309	002624	完美世界	7,251	147,267.81	0.08
310	000703	恒逸石化	13,810	146,662.20	0.08
311	603939	益丰药房	2,658	146,482.38	0.08
312	002372	伟星新材	6,000	145,920.00	0.08
313	002024	苏宁易购	35,200	145,024.00	0.08
314	002266	浙富控股	20,300	144,536.00	0.08
315	000831	五矿稀土	3,700	144,374.00	0.08
316	600486	扬农化工	1,100	144,320.00	0.08
317	002850	科达利	900	144,306.00	0.08
318	002353	杰瑞股份	3,600	144,000.00	0.08
319	601607	上海医药	7,200	143,064.00	0.08
320	002532	天山铝业	17,500	142,625.00	0.08
321	601198	东兴证券	12,200	141,886.00	0.08
322	300251	光线传媒	11,000	141,350.00	0.08
323	603338	浙江鼎力	1,760	141,257.60	0.08
324	300144	宋城演艺	9,820	140,622.40	0.08
325	000009	中国宝安	9,700	139,971.00	0.08
326	002223	鱼跃医疗	3,700	139,860.00	0.08
327	603613	国联股份	1,300	139,750.00	0.08
328	600606	绿地控股	32,160	139,574.40	0.08
329	601933	永辉超市	34,308	138,947.40	0.08
330	000519	中兵红箭	5,200	138,684.00	0.08

331	000630	铜陵有色	39,800	138,504.00	0.08
332	002409	雅克科技	1,700	137,989.00	0.08
333	002028	思源电气	2,800	137,788.00	0.08
334	601990	南京证券	13,900	137,749.00	0.08
335	600079	人福医药	6,100	137,372.00	0.08
336	600027	华电国际	25,600	136,960.00	0.08
337	002673	西部证券	16,842	135,914.94	0.08
338	002405	四维图新	8,500	135,320.00	0.08
339	688009	中国通号	27,031	134,614.38	0.08
340	600487	亨通光电	8,900	134,568.00	0.08
341	300253	卫宁健康	8,020	134,415.20	0.08
342	600705	中航产融	33,700	133,789.00	0.08
343	688208	道通科技	1,683	133,630.20	0.08
344	000932	华菱钢铁	26,100	133,371.00	0.08
345	600369	西南证券	25,100	132,779.00	0.08
346	601162	天风证券	32,700	132,435.00	0.08
347	002531	天顺风能	6,800	131,852.00	0.08
348	000807	云铝股份	11,800	131,806.00	0.08
349	300676	华大基因	1,500	131,700.00	0.08
350	600160	巨化股份	10,200	131,682.00	0.08
351	002444	巨星科技	4,300	131,193.00	0.08
352	688002	睿创微纳	1,665	130,819.05	0.08
353	600392	盛和资源	6,600	129,492.00	0.07
354	603127	昭衍新药	1,120	129,281.60	0.07
355	600109	国金证券	11,400	129,162.00	0.07
356	601077	渝农商行	33,400	128,590.00	0.07
357	000983	山西焦煤	15,490	128,102.30	0.07
358	600338	西藏珠峰	3,400	128,044.00	0.07
359	601699	潞安环能	11,300	127,803.00	0.07
360	300308	中际旭创	3,000	127,500.00	0.07
361	000155	川能动力	4,800	127,344.00	0.07
362	000728	国元证券	16,460	126,742.00	0.07
363	000999	华润三九	3,700	126,688.00	0.07
364	000591	太阳能	11,300	126,560.00	0.07
365	603444	吉比特	300	126,555.00	0.07
366	002508	老板电器	3,500	126,070.00	0.07
367	000629	攀钢钒钛	32,400	126,036.00	0.07
368	002407	多氟多	2,800	125,972.00	0.07
369	601319	中国人保	26,800	125,960.00	0.07
370	600655	豫园股份	12,200	125,660.00	0.07
371	002939	长城证券	9,700	125,615.00	0.07
372	603712	七一二	2,900	125,570.00	0.07

373	002507	涪陵榨菜	3,300	124,740.00	0.07
374	002032	苏泊尔	2,000	124,480.00	0.07
375	002497	雅化集团	4,300	123,238.00	0.07
376	002603	以岭药业	6,280	123,088.00	0.07
377	000960	锡业股份	6,300	123,039.00	0.07
377	601016	节能风电	18,900	123,039.00	0.07
378	603233	大参林	2,920	122,961.20	0.07
379	300088	长信科技	9,200	122,176.00	0.07
380	600143	金发科技	9,700	122,026.00	0.07
381	601866	中远海发	37,400	121,550.00	0.07
382	600521	华海药业	5,610	121,512.60	0.07
383	603658	安图生物	2,200	121,132.00	0.07
384	600170	上海建工	33,600	120,960.00	0.07
385	000027	深圳能源	14,920	120,852.00	0.07
386	600177	雅戈尔	17,500	120,575.00	0.07
387	000800	一汽解放	11,700	120,393.00	0.07
388	600549	厦门钨业	5,300	119,939.00	0.07
389	688185	康希诺	400	119,820.00	0.07
390	000050	深天马 A	9,200	119,784.00	0.07
391	300558	贝达药业	1,500	119,745.00	0.07
392	002456	欧菲光	12,300	119,310.00	0.07
393	601577	长沙银行	15,200	118,712.00	0.07
394	603218	日月股份	3,600	118,620.00	0.07
395	002463	沪电股份	7,100	117,718.00	0.07
396	002192	融捷股份	900	117,135.00	0.07
397	000423	东阿阿胶	2,400	117,000.00	0.07
398	002557	洽洽食品	1,900	116,584.00	0.07
399	002078	太阳纸业	10,100	116,049.00	0.07
400	600704	物产中大	19,600	116,032.00	0.07
401	002044	美年健康	14,776	115,991.60	0.07
402	300677	英科医疗	2,000	115,680.00	0.07
403	002797	第一创业	15,800	115,656.00	0.07
404	002157	正邦科技	11,900	114,954.00	0.07
405	002138	顺络电子	3,000	114,540.00	0.07
406	002294	信立泰	4,180	114,197.60	0.07
407	000998	隆平高科	4,900	113,974.00	0.07
408	603077	和邦生物	33,400	113,894.00	0.07
409	002299	圣农发展	4,700	113,599.00	0.07
410	600699	均胜电子	5,100	112,047.00	0.06
411	600872	中炬高新	2,949	111,973.53	0.06
412	002408	齐翔腾达	10,600	111,300.00	0.06
413	002152	广电运通	9,300	110,670.00	0.06

414	600711	盛屯矿业	10,300	110,519.00	0.06
415	000830	鲁西化工	7,200	109,872.00	0.06
416	300357	我武生物	1,900	108,870.00	0.06
417	002430	杭氧股份	3,600	108,036.00	0.06
418	300850	新强联	600	107,106.00	0.06
419	000860	顺鑫农业	2,800	106,904.00	0.06
420	300568	星源材质	2,900	106,517.00	0.06
421	002153	石基信息	3,698	106,280.52	0.06
422	000988	华工科技	3,800	105,868.00	0.06
423	002030	达安基因	5,276	105,836.56	0.06
424	300832	新产业	2,400	105,720.00	0.06
425	601456	国联证券	7,500	104,775.00	0.06
426	600998	九州通	7,031	103,496.32	0.06
427	300418	昆仑万维	4,400	101,860.00	0.06
428	002541	鸿路钢构	1,900	101,726.00	0.06
429	000987	越秀金控	11,675	101,572.50	0.06
430	603866	桃李面包	3,560	101,104.00	0.06
431	600315	上海家化	2,500	101,025.00	0.06
432	002010	传化智联	11,600	100,920.00	0.06
433	603638	艾迪精密	3,160	100,867.20	0.06
434	000683	远兴能源	13,800	100,740.00	0.06
435	600415	小商品城	20,700	100,395.00	0.06
436	002422	科伦药业	5,300	100,329.00	0.06
437	000547	航天发展	6,000	100,200.00	0.06
438	300725	药石科技	700	99,519.00	0.06
439	002925	盈趣科技	2,910	99,027.30	0.06
440	000709	河钢股份	40,100	98,646.00	0.06
441	300070	碧水源	13,700	98,503.00	0.06
442	600801	华新水泥	5,100	98,430.00	0.06
443	300296	利亚德	9,600	98,400.00	0.06
444	600153	建发股份	10,790	97,865.30	0.06
445	600598	北大荒	6,700	97,552.00	0.06
446	002926	华西证券	9,900	97,515.00	0.06
447	002156	通富微电	5,000	97,150.00	0.06
448	688202	美迪西	200	97,118.00	0.06
449	002145	中核钛白	7,700	96,943.00	0.06
450	600688	上海石化	23,030	96,035.10	0.06
451	600380	健康元	7,400	95,016.00	0.05
452	002465	海格通信	8,700	95,004.00	0.05
453	601696	中银证券	7,000	94,150.00	0.05
454	002690	美亚光电	2,500	93,650.00	0.05
455	000021	深科技	5,900	93,456.00	0.05

456	002092	中泰化学	9,700	92,538.00	0.05
457	000513	丽珠集团	2,300	92,483.00	0.05
458	600988	赤峰黄金	6,200	92,380.00	0.05
459	000975	银泰黄金	10,460	91,838.80	0.05
460	002065	东华软件	11,700	91,260.00	0.05
461	300136	信维通信	3,600	91,152.00	0.05
462	002558	巨人网络	7,600	90,972.00	0.05
463	000656	金科股份	20,100	90,048.00	0.05
464	601992	金隅集团	31,500	89,460.00	0.05
465	002500	山西证券	13,540	89,364.00	0.05
466	603858	步长制药	4,231	89,231.79	0.05
467	600848	上海临港	6,000	89,220.00	0.05
468	601231	环旭电子	5,519	88,635.14	0.05
469	300212	易华录	2,500	88,375.00	0.05
470	600511	国药股份	2,800	88,284.00	0.05
471	002373	千方科技	5,900	88,205.00	0.05
472	600895	张江高科	5,800	87,348.00	0.05
473	300773	拉卡拉	3,000	87,060.00	0.05
474	300383	光环新网	5,800	86,072.00	0.05
475	000750	国海证券	20,540	84,419.40	0.05
476	002212	天融信	4,400	84,348.00	0.05
477	002506	协鑫集成	22,100	83,980.00	0.05
478	002429	兆驰股份	17,100	83,106.00	0.05
479	300432	富临精工	2,800	82,320.00	0.05
480	002511	中顺洁柔	4,900	81,879.00	0.05
481	002958	青农商行	21,000	81,060.00	0.05
482	002563	森马服饰	10,100	78,073.00	0.04
483	600026	中远海能	13,100	77,552.00	0.04
484	000686	东北证券	8,800	77,264.00	0.04
485	600583	海油工程	16,700	76,987.00	0.04
486	600498	烽火通信	4,200	75,516.00	0.04
487	603883	老百姓	1,520	75,057.60	0.04
488	002151	北斗星通	1,900	74,575.00	0.04
489	601598	中国外运	16,500	73,920.00	0.04
490	002146	荣盛发展	16,400	71,340.00	0.04

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688082	盛美上海	1,067	121,936.76	0.07
2	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.06

3	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.04
4	688262	国芯科技	1,562	65,572.76	0.04
5	688236	春立医疗	1,812	47,891.16	0.03
6	688038	中科通达	2,132	39,911.04	0.02
7	301029	怡合达	391	35,139.17	0.02
8	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.02
9	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
10	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.01
11	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.01
12	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
13	301082	久盛电气	831	17,891.43	0.01
14	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
15	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
16	301155	海力风电	135	13,061.25	0.01
17	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
18	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.01
19	301035	润丰股份	208	11,706.24	0.01
20	301149	隆华新材	689	11,547.64	0.01
21	301118	恒光股份	234	11,470.68	0.01
22	301127	天源环保	640	10,956.80	0.01
23	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.01
24	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.01
25	301211	亨迪药业	281	9,455.65	0.01
26	301188	力诺特玻	458	9,379.84	0.01
27	301028	东亚机械	694	9,369.00	0.01
28	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.01
29	301039	中集车辆	744	9,307.44	0.01
30	301177	迪阿股份	80	9,286.40	0.01
31	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.01
32	301101	明月镜片	208	9,018.88	0.01
33	301126	达嘉维康	467	8,980.41	0.01
34	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.01
35	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
36	301138	华研精机	181	8,119.66	0.00
37	301087	可孚医疗	105	7,910.70	0.00
38	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
39	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
40	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
41	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
42	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
43	301221	光庭信息	80	7,097.60	0.00
44	301168	通灵股份	135	7,037.55	0.00
45	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00

46	301081	严牌股份	383	6,679.52	0.00
47	301182	凯旺科技	212	6,482.96	0.00
48	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
49	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
50	301198	喜悦智行	219	6,394.80	0.00
51	301049	超越科技	193	6,353.56	0.00
52	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
53	301100	风光股份	191	5,947.74	0.00
54	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
55	301189	奥尼电子	102	5,775.24	0.00
56	301093	华兰股份	115	5,732.75	0.00
57	301199	迈赫股份	176	5,632.00	0.00
58	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
59	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
60	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
61	301036	双乐股份	169	5,058.17	0.00
62	301190	善水科技	183	5,025.18	0.00
63	301193	家联科技	165	4,808.10	0.00
64	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
65	301088	戎美股份	192	4,736.64	0.00
66	301092	争光股份	133	4,724.16	0.00
67	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
68	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
69	301179	泽宇智能	90	4,569.30	0.00
70	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
71	301096	百诚医药	55	4,319.15	0.00
72	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
73	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
74	301108	洁雅股份	70	3,759.70	0.00
75	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	5,145,590.00	2.67
2	000858	五粮液	4,181,405.00	2.17
3	300760	迈瑞医疗	2,601,513.00	1.35
4	002594	比亚迪	2,286,959.00	1.19
5	600519	贵州茅台	2,189,418.00	1.13
6	000333	美的集团	2,099,969.00	1.09
7	000001	平安银行	1,692,095.00	0.88

8	002352	顺丰控股	1,544,136.00	0.80
9	600036	招商银行	1,513,480.00	0.78
10	300059	东方财富	1,371,233.30	0.71
11	000568	泸州老窖	1,334,578.00	0.69
12	002475	立讯精密	1,333,903.00	0.69
13	002714	牧原股份	1,324,781.80	0.69
14	300014	亿纬锂能	1,210,142.00	0.63
15	002812	恩捷股份	1,196,572.61	0.62
16	300015	爱尔眼科	1,148,170.41	0.60
17	300759	康龙化成	1,132,415.00	0.59
18	601318	中国平安	1,098,996.00	0.57
19	002049	紫光国微	1,089,567.00	0.56
20	601888	中国中免	1,069,260.00	0.55

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	5,824,555.00	3.02
2	000858	五粮液	5,150,036.82	2.67
3	002594	比亚迪	2,592,786.00	1.34
4	300760	迈瑞医疗	2,578,481.00	1.34
5	002415	海康威视	2,410,016.76	1.25
6	000001	平安银行	2,028,798.15	1.05
7	000333	美的集团	1,786,305.36	0.93
8	002714	牧原股份	1,711,682.90	0.89
9	000568	泸州老窖	1,645,833.00	0.85
10	002475	立讯精密	1,637,910.05	0.85
11	600519	贵州茅台	1,595,282.44	0.83
12	300059	东方财富	1,567,223.00	0.81
13	002352	顺丰控股	1,497,145.72	0.78
14	300015	爱尔眼科	1,367,427.80	0.71
15	300014	亿纬锂能	1,348,896.00	0.70
16	000002	万科 A	1,341,786.00	0.70
17	002304	洋河股份	1,295,325.00	0.67
18	300122	智飞生物	1,227,448.00	0.64
19	002812	恩捷股份	1,226,440.00	0.64
20	002142	宁波银行	1,222,280.00	0.63

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	160,386,961.10
卖出股票收入（成交）总额	164,707,604.90

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	192,000.00	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	192,000.00	0.11

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	1,890	189,000.00	0.11
2	113634	珀莱转债	30	3,000.00	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

1、兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”，股票代码：601166）于 2021 年 8 月 13 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银罚字〔2021〕26 号），其因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，被处以罚款人民币 5 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对兴业银行进行了投资。

2、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2021〕16 号）。其因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财产品之间风险隔离不到位等二十七项违法违规事实，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，被处以罚款 7170 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对招商银行进行了投资。

3、其余八名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	31,134.97
2	应收证券清算款	99,802.94
3	应收股利	-
4	应收利息	866.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	131,804.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688082	盛美上海	121,936.76	0.07	新股流通受限
2	688296	和达科技	107,932.91	0.06	新股流通受限
3	688071	华依科技	68,603.31	0.04	新股流通受限
4	688262	国芯科技	65,572.76	0.04	新股流通受限
5	688236	春立医疗	47,891.16	0.03	新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构****9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,387	70,660.23	21,698,216.00	22.14	53,954,724.00	55.05

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国农业银行股份有限公司—景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金	22,352,800.00	22.81

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国农业银行股份有限公司—景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金	22,352,800.00	22.81
2	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	11,890,600.00	12.13
3	广发证券股份有限公司	5,277,859.00	5.39
4	唐崇霖	2,568,000.00	2.62
5	中信证券股份有限公司	2,195,315.00	2.24
6	张晓川	2,000,000.00	2.04
7	张红	1,790,400.00	1.83
8	张宇锋	1,670,500.00	1.70
9	林李丽琴	1,600,000.00	1.63
10	中信建投证券股份有限公司	1,597,781.00	1.63
11	郭莉芬	1,389,900.00	1.42

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年4月27日） 基金份额总额	1,534,005,740.00
-------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	122,005,740.00
本报告期基金总申购份额	82,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	106,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	98,005,740.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本管理人于 2021 年 3 月 30 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任刘彦春先生担任本公司副总经理。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

1、2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2、2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 4 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 55,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融股份有限公司	2	127,602,820.87	40.64%	118,837.99	40.90%	-
长江证券股份有限公司	2	33,471,742.55	10.66%	31,172.73	10.73%	-
方正证券股份有限公司	2	32,135,901.73	10.24%	29,929.87	10.30%	-
光大证券股份有限公司	2	20,576,375.26	6.55%	19,163.42	6.60%	-
海通证券股份有限公司	1	14,357,388.03	4.57%	13,371.65	4.60%	-
兴业证券股份有限公司	1	14,155,523.36	4.51%	13,183.03	4.54%	-
中信证券股份有限公司	5	13,274,089.40	4.23%	10,486.74	3.61%	本期新增1个
川财证券有限责任公司	1	11,559,112.47	3.68%	10,766.22	3.71%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	7,045,071.35	2.24%	6,561.20	2.26%	-
瑞银证券有限责任公司	1	5,787,603.79	1.84%	5,390.21	1.86%	-
中泰证券股份有限公司	2	5,584,281.91	1.78%	5,200.59	1.79%	-
国盛证券有限责任公司	1	5,194,162.43	1.65%	4,837.44	1.66%	-
申万宏源证券有限公司	1	4,651,354.17	1.48%	4,331.95	1.49%	-
国信证券股份有限公司	1	2,473,843.53	0.79%	2,303.94	0.79%	-
华创证券有限责任公司	1	2,432,332.70	0.77%	2,265.44	0.78%	-
东兴证券股份有限公司	1	2,343,942.96	0.75%	2,182.91	0.75%	-
东北证券股份有限公司	2	2,158,296.37	0.69%	2,010.42	0.69%	本期新增1个
安信证券股份有限公司	1	1,909,969.96	0.61%	1,778.74	0.61%	-
中国银河证券股份有限公司	2	1,836,104.47	0.58%	1,710.11	0.59%	-
广发证券股份有限公司	1	1,604,154.02	0.51%	1,493.97	0.51%	-
平安证券股份有限公司	2	1,089,889.89	0.35%	1,014.99	0.35%	-
国金证券股份有限公司	1	821,227.79	0.26%	764.85	0.26%	-
招商证券股份有限公司	2	728,133.81	0.23%	678.12	0.23%	-
东方证券股份有限公司	2	720,503.33	0.23%	671.04	0.23%	-
申港证券股份有限公司	1	267,288.00	0.09%	248.94	0.09%	-
西南证券股份有限公司	1	149,875.00	0.05%	139.61	0.05%	-
新时代证券股份有限公司	1	45,802.86	0.01%	42.65	0.01%	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	4,029.68	0.72%	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	97,729.64	17.44%	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	89,195.90	15.92%	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	43,224.42	7.71%	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	79,736.80	14.23%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	51,516.29	9.19%	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	47,852.40	8.54%	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	82,262.40	14.68%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	12,941.39	2.31%	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	9,555.00	1.70%	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	42,393.56	7.56%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-08
2	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
4	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-05
6	景顺长城基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09

7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-20
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
12	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
13	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同（基金合同更新）	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
14	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
15	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
17	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
19	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-12
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-15
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-19
22	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-20
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
24	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22

25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
27	关于旗下部分基金新增中信证券（华南）为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
28	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-20
29	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-15
31	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
32	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-09
33	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-13
34	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-16
35	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-20
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
37	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-21
38	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-23
39	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-27
40	关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金新增中金财富证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-03
41	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-06
42	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-20
43	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23
44	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-23

45	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-27
46	景顺长城基金将积极参与投资北京证券交易所上市企业	中国证监会指定报刊及网站	2021-09-07
47	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-15
48	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-15
49	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-22
50	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-27
51	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-27
52	景顺长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票的风险提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-16
53	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-18
54	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-30
55	景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-30
56	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-03
57	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-10
58	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-16
59	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-17
60	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-24
61	景顺长城基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-29

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
本基金的联接基金	1	20210101-20211231	27,922,500.00	22,440,000.00	28,009,700.00	22,352,800.00	22.81

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》等法律法规及各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，

并向中国证监会备案，我司对旗下包括本基金在内的 15 只基金的基金合同等法律文件进行修订。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2021 年 3 月 29 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2022 年 3 月 28 日